

F-PYME
FONDO BBVA BANCOMER DEUDA EMPRESAS S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 2017

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
DISPONIBILIDADES					
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN					
CHD	BACOMER	0731625		.00	.00
TOTAL DISPONIBILIDADES					
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					
VALORES GUBERNAMENTALES					
IM	BPAG28	190725	mxAAA	150,041,319.00	.81
IS	BPA182	180104	mxAAA	574,251,313.50	3.09
IS	BPA182	180705	mxAAA	202,273,247.03	1.09
IS	BPA182	190103	mxAAA	306,798,345.00	1.65
LD	BONDESD	180215	mxAAA	290,284,890.20	1.56
LD	BONDESD	180328	mxAAA	612,054,900.48	3.29
LD	BONDESD	180405	mxAAA	303,814,110.98	1.63
LD	BONDESD	180419	mxAAA	2,636,043,786.50	14.17
LD	BONDESD	180614	mxAAA	152,720,880.12	.82
LD	BONDESD	180628	mxAAA	837,747,359.30	4.50
LD	BONDESD	181011	mxAAA	300,955,977.00	1.62
TÍTULOS BANCARIOS					
F	BACOMER	17084	mxA-1+	602,609,598.00	3.24
F	BACOMER	17094	mxA-1+	350,578,987.50	1.88
F	BACOMER	17116	mxA-1+	200,540,242.00	1.08
F	BANAMEX	7432	mxA-1+	703,922,394.00	3.78
F	BANAMEX	7438	mxA-1+	60,260,959.80	.32
F	BSCTIA	17005	mxA-1+	200,542,402.00	1.08
F	BSCTIA	17012	mxA-1+	115,215,973.45	.62
F	BSCTIA	17013	mxA-1+	115,215,973.45	.62
F	BSCTIA	17032	mxA-1+	390,403,825.50	2.10
F	HSBCMX	17004	mxA-1+	551,515,420.50	2.96
I	BACMEXT	17464	mxA-1+	1,313,439,141.55	7.06
PAPEL PRIVADO					
91	METROCB	07	mxD	287,230.02	.00
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA				10,971,518,276.88	58.96
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				10,971,518,276.88	58.96
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADO					
IQ	BPAG91	190417	mxAAA	1,924,631,140.68	10.34
IQ	BPAG91	200423	mxAAA	1,778,161,164.73	9.56
IQ	BPAG91	210422	mxAAA	1,856,396,520.02	9.98
LD	BONDESD	191003	mxAAA	1,198,128,550.98	6.44
LD	BONDESD	200924	mxAAA	878,411,960.46	4.72
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO				7,635,729,336.87	41.04
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				18,607,247,613.75	100.00

CLASIFICACIÓN
101

CALIFICACIÓN
AAA/1

VaR Promedio Mes
0.004049%

Límite de VaR
0.026%

Valor en Riesgo (VaR). El método de VaR utilizado es el histórico, para su cálculo se utilizan las matrices de escenarios proporcionadas por el Proveedor Oficial de Precios. La matriz incluye 500 escenarios de pérdida para cada uno de los instrumentos en el mercado. Se valúa el portafolio con cada uno de los escenarios y se ordenan los resultados de menor a mayor obteniendo el 13avo peor el cual corresponde al VaR al 95% de confianza. El VaR que se presenta es el promedio simple de la última semana

El riesgo por invertir en instrumentos financieros derivados, certificados bursátiles fiduciarios y valores estructurados o respaldados por activos en caso de tenerlos en el fondo consiste en el impacto negativo debido al movimiento en los factores que afecten directamente al subyacente adquirido a través de alguno de los instrumentos referidos; la ganancia o pérdida en estos instrumentos puede ser muy alta debido a que los factores de riesgo implícitos como movimiento de tasas de interés, tipos de cambio o inflación por mencionar algunos pueden afectar al instrumento de forma simultánea pudiendo aumentar la volatilidad de los valores, lo anterior implica que el riesgo asociado es alto.